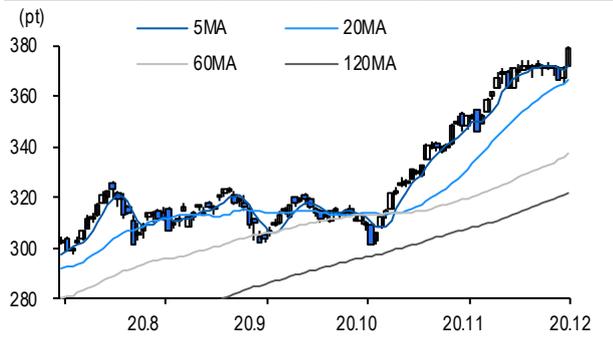


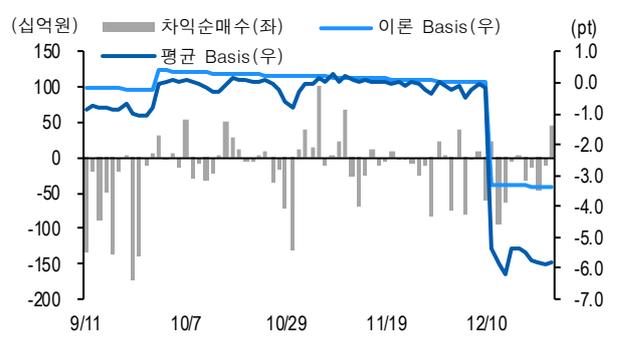


선물옵션시장 지표 2020.12.28

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	379.18	2.12	7.86	14,179.3	-
선물 12월물	374.10	2.31	8.45	27,769.9	234,057
선물 3월물	373.60	2.22	8.10	10.4	13,378
12월물(mini)	373.26	2.12	7.76	4,823.0	104,055
1월물(mini)	373.80	2.27	8.28	19.4	1,193

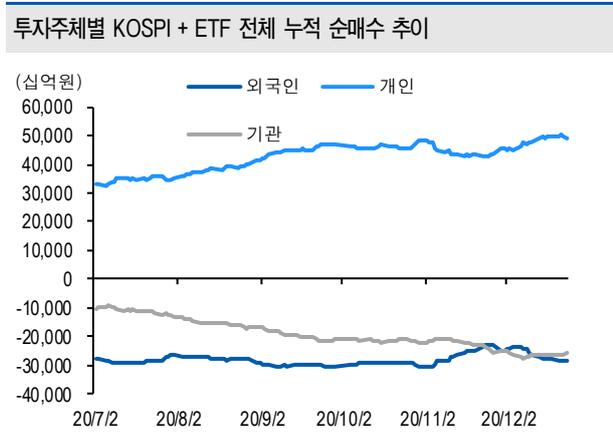


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	-3.36	-5.83	-5.08	-0.65%	
베이스(mini)	-2.37	-5.97	-5.92	-0.95%	
제1스프레드(SP)	0.01	-0.38	-0.50	-0.10%	
합성선물 베이스(ATM)	-2.37	-5.12	-5.12	-0.73%	

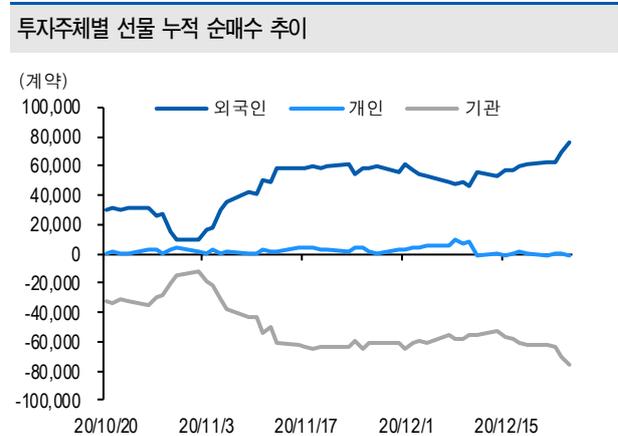


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	109.8	34.3	144.1	-2.1	79.0	44.0	605.3	-12.6	5.3	-6.6	
개인	-746.3	-25.4	-771.7	0.0	-5.8	-111.2	-7.4	9.8	-2.7	108.3	
기관	627.3	-17.2	610.1	47.1	-176.6	135.6	-576.9	2.8	-2.0	-104.7	
금융투자	758.6	45.7	804.2	56.9	-13.0	-176.8	-576.8	2.6	-2.3	-221.2	
투신	-0.9	-16.0	-16.9	0.0	-26.7	260.1	-0.1	0.1	-0.1	111.9	
은행+보험+기타금융	-57.1	-29.0	-86.1	0.0	-41.6	40.1	0.0	0.0	0.3	2.4	
연기금+국가자재	-98.8	-22.7	-121.5	-9.7	-98.5	12.1	0.0	0.0	0.0	2.2	
기타법인	9.2	8.3	17.5	0.0	0.0	-68.4	-21.0	0.0	-0.6	3.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,408,570	586.2	632,407	15.9%	지수옵션 전체	2,748,683	959.6	1,868,758
Put	1,340,113	373.4	1,236,351	21.1%	PCR(금액기준)	0.64	VKOSPI	21.53%(+0.01%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	3.94	2.30	110,816	16,448	2,901	16.0	Put	375.0(K+1)	7.10	-5.30	1,374	1,251	705	20.0
	377.5(K+2)	4.92	2.77	92,969	9,941	1,207	15.9		372.5(K+0)	5.93	-4.57	12,225	5,363	4,203	20.0
	375.0(K+1)	6.08	3.33	41,120	10,477	2,498	15.9		370.0(K-1)	5.16	-3.81	11,865	5,299	1,603	20.8
	372.5(K+0)	7.49	3.94	26,001	10,172	3,783	16.0		367.5(K-2)	4.31	-3.29	8,529	5,335	625	21.0
	370.0(K-1)	8.92	4.38	8,973	9,824	383	15.8		365.0(K-3)	3.58	-2.84	14,895	9,346	630	21.3

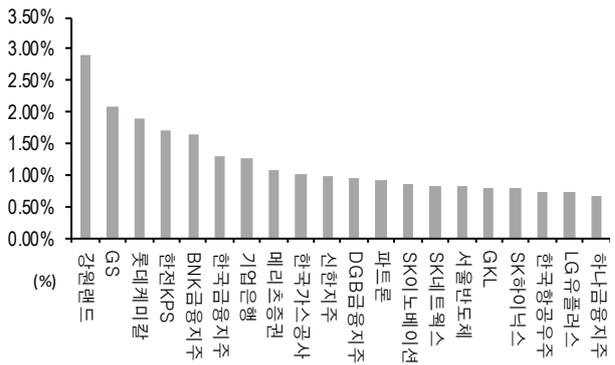
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목) (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	5,136,737	4,341.1	6,645,085	193,193	-5,512	149,016	-151,217	-6.6	108.3	-104.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	76,800	5.35	1,798.3	72.5	1,438,903	97,945	-0.90%	-11,685	46,916	-36,348	-65,381	-1,508
LG 화학	809,000	1.00	151.7	68.7	23,354	936	-0.55%	62	-112	65	-761	346
SK 하이닉스	117,000	1.30	229.9	56.2	365,309	28,519	0.80%	-1,821	3,727	-1,965	-23,335	335
삼성전기	168,000	0.60	44.3	55.2	41,977	3,698	0.60%	1,036	134	-1,178	-1,829	-2,494
LG 이노텍	174,500	-4.12	61.6	50.7	17,873	-2,978	-0.26%	746	308	-1,286	-4,180	-154
기아차	61,100	0.99	39.5	50.5	118,639	-10,777	0.38%	-8,213	-924	9,137	5,156	11,120
한화솔루션	45,600	-2.56	38.9	48.0	54,897	2,882	0.11%	-2,891	1,170	1,721	-1,625	921
카카오	374,500	-1.19	80.5	46.3	35,748	-1,764	0.09%	-127	-2,416	2,530	628	1,474
롯데케미칼	262,500	2.94	35.5	45.4	10,368	-210	1.90%	-330	132	174	-955	-117
현대차	185,500	1.37	85.5	43.2	86,758	3,610	0.37%	-1,454	1,122	213	-1,593	-940

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터